

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Владимирский государственный университет
имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»
(ВлГУ)

Институт экономики и менеджмента

УТВЕРЖДАЮ

Директор института экономики и
менеджмента



П.Н. Захаров
2022 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

ПЛАНИРОВАНИЕ И ПРОГНОЗИРОВАНИЕ ЭКОНОМИЧЕСКИХ РИСКОВ

направление подготовки/специальность
38.03.01 «Экономика»

направленность (профиль) подготовки
«Экономика предприятий и организаций»

г. Владимир
2022

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения дисциплины «Планирование прогнозирование экономических рисков» является формирование представлений о методологии планирования и прогнозирования рисков, а также овладение практикой применения полученных знаний для принятия эффективных управленческих решений.

Задачами дисциплины являются:

- освоение общетеоретических положений анализа и планирования рисков;
- овладение умениями и навыками планирования и прогнозирования рисков;
- овладение приемами, методами и методиками диагностики рисков явлений.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина «Планирование прогнозирование экономических рисков» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений.

3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения ОПОП (компетенциями и индикаторами достижения компетенций)

Формируемые компетенции (код, содержание компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине, в соответствии с индикатором достижения компетенции		Наименование оценочного средства
	Индикатор достижения компетенции (код, содержание индикатора)	Результаты обучения по дисциплине	
ПК-4. Способен составлять регулярную аналитическую отчетность для клиентов и высшего руководства	ПК-4.3. Владеет базовыми навыками систематизации информации, необходимой для формирования регулярной аналитической отчетности, обеспечения ее сохранности и конфиденциальности	Знает методы систематизации информации в области планирования и прогнозирования рисков Умеет формировать аналитическую отчетность с учетом фактора риска Владеет базовыми навыками систематизации информации в области планирования и прогнозирования рисков	Тестовые задания Практико-ориентированные практические задания
ПК-5. Способен осуществлять расчеты по управлению рисками и разрабатывать мероприятия совместно с ответственными за риск сотрудниками	ПК-5.1. Знает методы, техники, технологии управления различными видами риска, инструменты анализа существующих методов контроля рисков и управления рисками и их достаточности; инструменты анализа последствий рисков, а также законодательство Российской Федерации, отраслевые и международные стандарты по управлению рисками	Знает методы, инструменты анализа существующих методов контроля планирования и прогнозирования рисков Умеет анализировать последствия риска в профессиональной сфере деятельности Владеет техниками и технологиями планирования и прогнозирования рисков	Тестовые задания Практико-ориентированные практические задания

<p>ПК-6 Способен представлять аналитическую информацию о рисках и документировать процесс управления рисками и корректировать реестр рисков в рамках отдельных бизнес –процессов и функциональных направлений</p>	<p>ПК-6.3. Владеет навыками обеспечения информацией текущего управления рисками на постоянной основе и корректировки реестра рисков в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений</p>	<p>Знает методы отбора нужной информации для планирования и прогнозирования рисков Умеет проводить корректировку реестра рисков в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений Владеет навыками обеспечения информацией текущего управления рисками</p>	<p>Тестовые задания Практико-ориентированные практические задания</p>
---	--	---	--

4. ОБЪЕМ И СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетные единицы, 144 часов.

**Тематический план
форма обучения – очная**

№ п/п	Наименование тем и/или разделов/тем дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Контактная работа обучающихся с педагогическим работником				Самостоятельная работа	Формы текущего контроля успеваемости, форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	в том числе в форме практической подготовки		
1.	Роль учета рисков в процессах планирования и прогнозирования	6	1-2	2	2		1	8	
2.	Качественные методы планирования и прогнозирования риска	6	3	2	2		1	8	
3.	Количественные методы планирования и прогнозирования риска	6	4	2	2		1	8	
4.	Методы математического программирования для прогнозирования рисков	6	5-6	2	2		1	8	рейтинг-контроль № 1
5.	Кумулятивное распределение потерь в процессе планирования и прогнозирования рисков	6	7-8	2	2		1	11	
6.	Аналитические методы оценки риска	6	9-10	2	2		1	8	
7.	Шкалирование и картографирование рисков	6	11-12	2	2		1	15	рейтинг-контроль № 2
8.	Основные методы планирования и прогнозирования рисков	6	13-18	4	4		2	15	рейтинг-контроль № 3
Наличие в дисциплине КПКР		да							
Итого по дисциплине			144 ч.	18	18		9	81	Экзамен, 27

**Тематический план
форма обучения – очно-заочная**

№ п/п	Наименование тем и/или разделов/тем дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Контактная работа обучающихся с педагогическим работником				Самостоятельная работа	Формы текущего контроля успеваемости, форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	в том числе в форме практической подготовки		
1	Роль учета рисков в процессах планирования и прогнозирования	7	1-2	1	2		1	10	
2	Качественные методы планирования и прогнозирования риска	7	3	1	2		1	10	
3	Количественные методы планирования и прогнозирования риска	7	4	2	2		1	11	
4	Методы математического программирования для прогнозирования рисков	7	5-6	2	2		1	11	рейтинг-контроль № 1
5	Кумулятивное распределение потерь в процессе планирования и прогнозирования рисков	7	7-8	2	2		1	10	
6	Аналитические методы оценки риска	7	9-10	2	2		1	11	
7	Шкалирование и картографирование рисков	7	11-12	2	2		1	11	рейтинг-контроль № 2
8	Основные методы планирования и прогнозирования рисков	7	13-18	2	4		2	11	рейтинг-контроль № 3
Наличие в дисциплине КПКР		да							
Итого по дисциплине			144ч.	14	18		9	85	Экзамен, 27

Тематический план
форма обучения – очно-заочная, ускоренное обучение на базе СПО

№ п/п	Наименование тем и/или разделов/тем дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Контактная работа обучающихся с педагогическим работником				Самостоятельная работа	Формы текущего контроля успеваемости, форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	в том числе в форме практической подготовки		
1	Роль учета рисков в процессах планирования и прогнозирования	5	1-2	1	2		1	12	
2	Качественные методы планирования и прогнозирования риска	5	3	1	2		1	11	
3	Количественные методы планирования и прогнозирования риска	5	4	2	2		1	10	
4	Методы математического программирования для прогнозирования рисков	5	5-6	2	2		1	10	рейтинг-контроль № 1
5	Кумулятивное распределение потерь в процессе планирования и прогнозирования рисков	5	7-8	2	2		1	10	
6	Аналитические методы оценки риска	5	9-10		2		1	12	
7	Шкалирование и картографирование рисков	5	11-12	2	2		1	12	рейтинг-контроль № 2
8	Основные методы планирования и прогнозирования рисков	5	13-18		2		1	14	рейтинг-контроль № 3
Наличие в дисциплине КПКР		да							
Итого по дисциплине			144ч.	10	16		8	91	Экзамен, 27

СОДЕРЖАНИЕ ЛЕКЦИОННЫХ ЗАНЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Тема 1. Роль учета рисков в процессах планирования и прогнозирования: понятие, принципы планирования и прогнозирования.

Тема 2. Качественные методы планирования и прогнозирования риска: основные методы и приемы, их роль в процессе планирования и прогнозирования рисков.

Тема 3. Количественные методы планирования и прогнозирования риска: основные методы и приемы, их роль в процессе планирования и прогнозирования рисков

Тема 4. Методы математического программирования для прогнозирования рисков: статистический метод, кривая вероятностей потерь

Тема 5. Кумулятивное распределение потерь в процессе планирования и прогнозирования рисков: методика построения кривых Лоренца, индекс Джинни

Тема 6. Аналитические методы оценки риска: расчет точки безубыточности, коэффициенты финансовой устойчивости

Тема 7. Шкалирование и картографирование рисков: основные положения, обзор существующих методик, описание возможных областей применения.

Тема 8. Основные методы планирования и прогнозирования рисков: оценка точности прогнозов: основные статистические методы прогнозирования рисков, области их применения, достоинства и недостатки

СОДЕРЖАНИЕ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Тема 1. Роль учета рисков в процессах планирования и прогнозирования

- понятие риска;

- значение риска в процессах планирования и прогнозирования.

Тема 2. Качественные методы планирования и прогнозирования риска

- основные методы и приемы качественного планирования риска.

Тема 3. Количественные методы планирования и прогнозирования риска

- основные методы и приемы количественного планирования риска.

Тема 4. Методы математического программирования для прогнозирования рисков

- применение статистического метода,

- построение кривой вероятностей потерь

Тема 5. Кумулятивное распределение потерь в процессе планирования и прогнозирования рисков

- построения кривых Лоренца

- расчет индекс Джинни

Тема 6. Аналитические методы оценки риска

- расчет точки безубыточности графическим и расчетным способом

- вычисления и интерпретация коэффициентов финансовой устойчивости в процессе планирования и прогнозирования рисков

Тема 7. Шкалирование и картографирование рисков

- применение методов шкалирования рисков в процессе планирования и прогнозирования рисков

- картографирование рисков: основные методы и приемы

Тема 8. Основные методы планирования и прогнозирования рисков. Оценка точности прогнозов

- метод экстраполяции

- метод регрессии

- методы оценки достоверности прогноза.

5. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ИТОГАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

5.1 ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ

Рейтинг-контроль №1

1. Историко-ассоциативные методы анализа риска
2. Литературно-фантастические аналогии как качественный метод оценки риска в процессе планирования и прогнозирования
3. Концептуальные переносы
4. Рейтинг-метод
5. Метод экспертных оценок (экспертиза)
6. Статистический метод прогнозирования рисков
7. Кривая вероятностей потерь и ее интерпретация
8. Основные количественные методы планирования и прогнозирования риска: сущность и краткая характеристика.

Рейтинг-контроль №2

9. Расчет кумулятивного распределения потерь в процессе планирования и прогнозирования рисков
10. Расчет точки безубыточности в процессе планирования и прогнозирования рисков
11. Интерпретация основных коэффициентов финансовой устойчивости.
12. Обзор основных методов шкалирования рисков. Область применения.
13. Картографирование рисков: основные методы.

Рейтинг-контроль №3

14. Экстраполяция как один из методов планирования и прогнозирования рисков
15. Модель Альтмана
16. Построение дерева решений
17. Понятие линейной регрессии. Виды
18. Понятие линейной регрессии. Способы расчета
19. Интерпретация основных показателей линейной регрессии
20. Оправдываемость как показатель достоверности прогноза.
21. Предсказуемость как показатель достоверности прогноза.
22. Ошибки 1го и 2го рода при оценке достоверности прогноза. Интерпретация и методики расчета.
23. Понятие биномиального распределения. Значение расчета в планировании и прогнозировании рисков.

5.2 ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ

Вопросы к экзамену

1. Историко-ассоциативные методы анализа риска
2. Литературно-фантастические аналогии как качественный метод оценки риска в процессе планирования и прогнозирования
3. Концептуальные переносы
4. Рейтинг-метод
5. Метод экспертных оценок (экспертиза)
6. Статистический метод прогнозирования рисков
7. Кривая вероятностей потерь и ее интерпретация
8. Основные количественные методы планирования и прогнозирования риска: сущность и краткая характеристика.
9. Расчет кумулятивного распределения потерь в процессе планирования и прогнозирования рисков
10. Расчет точки безубыточности в процессе планирования и прогнозирования рисков
11. Интерпретация основных коэффициентов финансовой устойчивости.
12. Обзор основных методов шкалирования рисков. Область применения.
13. Картографирование рисков: основные методы.

14. Экстраполяция как один из методов планирования и прогнозирования рисков
15. Модель Альтмана
16. Построение дерева решений
17. Понятие линейной регрессии. Виды
18. Понятие линейной регрессии. Способы расчета
19. Интерпретация основных показателей линейной регрессии
20. Оправдываемость как показатель достоверности прогноза.
21. Предсказуемость как показатель достоверности прогноза.
22. Ошибки 1го и 2го рода при оценке достоверности прогноза. Интерпретация и методики расчета.
23. Понятие биномиального распределения. Значение расчета в планировании и прогнозировании рисков.
24. Методы имитационного моделирования в процессах планирования и прогнозирования риска
25. Использование коэффициента вариации при оценке риска
26. Соотношение понятий риска и доходности финансовых активов
27. Вероятностные критерии степени риска
28. Роль планирования и прогнозирования рисков в современной экономике
29. Среднее ожидаемое значение риска. Методики расчета. Интерпретация.

Тематика курсовых работ

1. Риск в экономической и предпринимательской деятельности.
2. Анализ рисков организации. Источники информации о рисках.
3. Методы идентификации рисков. Картографирование рисков организации.
4. Методы оценки рисков. Статистические методы оценки рисков: сравнительный анализ и условия применения.
5. Методы оценки рисков. Аналитические методы оценки рисков. Развитие аналитических методов оценки рисков в практике риск-менеджмента.
6. Экспертные методы оценки рисков. Получение индивидуальных и коллективных экспертных оценок: достоинства и недостатки применяемых методов.
7. Предпринимательские риски: сущность, понятие, методы оценки и управления.
8. Методы управления финансовыми рисками. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.
9. Кредитные риски. Роль доллара в современных международных валютных и кредитных отношениях.
10. Валютные риски. Мировой валютный рынок: современное состояние и перспективы развития.
11. Процентные риски. Влияние учетной ставки процента на экономическую активность. Процентные риски в системе банковских рисков.
12. Операционные риски: идентификация и оценка. Выбор критерия управления операционными рисками.
13. Рыночные риски. Методы оценки и инструменты регулирования.
14. Риски ликвидности. Анализ денежных потоков организации как метод управления рисками ликвидности. Пути повышения ликвидности и платежеспособности организации.
15. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация. Поиск наиболее эффективного пути развития.
16. Инвестиционные риски. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта.
17. Инвестиционные риски. Формирование инвестиционного портфеля с учетом риска.
18. Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и перспективы глобализации.
19. Страновые риски. Мировой экономический кризис и тенденции развития российской экономики.
20. Политические риски.

21. Техногенные риски.
22. Принятие решений в условиях неопределенности и риска.
23. Диагностика финансового кризиса предприятия. Анализ рисков при угрозе банкротства. Риски в глобальной экономике: основные подходы к управлению.
24. Риски мировой валютной системы. Перспективы кризиса.
25. Цифровые риски.
26. Особенности анализа и управления рисками по видам экономической деятельности.
27. Региональные риски.
28. Криптовалютные риски.
29. Аутсорсинг в управлении рисками.
30. Пенсионное страхование.
31. Инновационные риски.
32. Особенности управления рисками в зависимости от стадии жизненного цикла компании.
33. Особенности управления рисками в зависимости от стадии жизненного цикла товара.

5.3 САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Тема 1. Роль учета рисков в процессах планирования и прогнозирования:

- изучение литературы по указанной тематике;
- подготовка к дискуссии на тему «Соотношение риска и доходности: примеры мировой и отечественной практики»

Тема 2. Качественные методы планирования и прогнозирования риска:

- изучение литературы по указанной тематике.

Тема 3. Количественные методы планирования и прогнозирования риска:

- изучение литературы по указанной тематике.

Тема 4. Методы математического программирования для прогнозирования рисков

- изучение литературы по указанной тематике.
- подготовка докладов на тему «Методы имитационного моделирования в процессах планирования и прогнозирования риска»

Тема 5. Кумулятивное распределение потерь в процессе планирования и прогнозирования рисков

- изучение литературы по указанной тематике.

Тема 6. Аналитические методы оценки риска:

- изучение литературы по указанной тематике.
- подготовка докладов на тему «Влияние рисков на финансовую устойчивость организации»

Тема 7. Шкалирование и картографирование рисков

- изучение литературы по указанной тематике.

Тема 8. Основные методы планирования и прогнозирования рисков. Оценка точности прогнозов.

- изучение литературы по указанной тематике.
- подготовка докладов на тему «Методы имитационного моделирования в процессах планирования и прогнозирования риска»

Фонд оценочных материалов (ФОМ) для проведения аттестации уровня сформированности компетенций обучающихся по дисциплине оформляется отдельным документом.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. КНИГООБЕСПЕЧЕННОСТЬ

Наименование литературы: (автор, название, вид издания, город, издательство)	Год издания	КНИГООБЕСПЕЧЕННОСТЬ
		Наличие в электронной библиотеке (электронный адрес)
1	2	3
Основная литература		
Бизнес-планирование : учебник / под ред. проф. Т.Г. Попадюк, проф. В.Я. Горфинкеля. — Москва : Вузовский учебник : ИНФРА-М, 2021. — 296 с. - ISBN 978-5-9558-0270-1.	2021	https://znanium.com/catalog/document?id=368981
Бизнес-планирование : учебник / под ред. Т.Г. Попадюк, В.Я. Горфинкеля. — Москва : Вузовский учебник : ИНФРА-М, 2021. — 296 с.	2021	https://znanium.com/catalog/document?id=374317
Петрученя, И. В. Бизнес-планирование : монография / И. В. Петрученя, А. С. Буйневич. - Красноярск : Сиб. федер. ун-т, 2021. - 196 с. - ISBN 978-5-7638-4392-7.	2021	https://znanium.com/catalog/document?id=380436
Баринов, В. А. Бизнес-планирование : учебное пособие / В.А. Баринов. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : ФОРУМ : ИНФРА-М, 2020. — 272 с.	2020	https://znanium.com/catalog/document?id=354447
Дополнительная литература:		
Либерман, И. А. Планирование на предприятии : учебное пособие / И. А. Либерман. - 3-е изд. - Москва : РИОР : ИНФРА-М, 2019. - 205 с. - (Карманное учебное пособие). - ISBN 978-5-369-00587-3.	2019	https://znanium.com/catalog/document?id=372099
Савкина, Р. В. Планирование на предприятии : учебник для бакалавров / Р. В. Савкина. - 3-е изд., стер. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. — 320 с. - ISBN 978-5-394-03481-7.	2020	https://znanium.com/catalog/document?id=358443
Янковская, В. В. Планирование на предприятии : учебник / В. В. Янковская. - Москва : ИНФРА-М, 2019. - 425 с. —ISBN 978-5-16-004280-0.	2019	https://znanium.com/catalog/document?id=337740
Сачко, Н. С. Планирование и организация машиностроит. производства. Курсовое проект.: Уч. пос. / Н.С.Сачко, И.М.Бабук. - 2-е изд., испр. - М.: НИЦ Инфра-М; Мн.: Нов. знание, 2019. - 240 с.	2019	https://znanium.com/catalog/document?id=354389
Литвинова, Т. Н. Планирование на предприятии (в организации) : учеб. пособие / Т.Н. Литвинова, И.А. Морозова, Е.Г. Попкова. — Москва : ИНФРА-М, 2018. — 156 с	2018	https://znanium.com/catalog/document?id=300448

6.2 ПЕРИОДИЧЕСКИЕ ИЗДАНИЯ

1. Журнал «Вестник ВлГУ. Серия: Экономические науки» (Режим доступа: <http://vestnik-es.vlsu.ru>)

2. Журнал «Проблемы прогнозирования» (Режим доступа: <https://ecfor.ru/nauchnye-izdaniya/problemy-prognozirovaniya/arhiv-nomerov/>)
3. Журнал «RUSSIAN ECONOMY: FORECASTS AND TRENDS» (Режим доступа: <https://rusecon.hse.ru/>)
4. Журнал «Прогнозы и стратегии» (Режим доступа: <http://www.maib.ru/bookspublication/pis/>)
5. Журнал «ЭКОНОМИЧЕСКИЕ И СОЦИАЛЬНЫЕ ПЕРЕМЕНЫ: ФАКТЫ, ТЕНДЕНЦИИ, ПРОГНОЗ» (Режим доступа: <http://esc.isert-ran.ru/archive>)

6.3. ИНТЕРНЕТ-РЕСУРСЫ

1. Федеральная служба государственной статистики // <https://gks.ru/>
2. Банк статистических баз данных ГУ-ВШЭ www.stat.hse.ru
3. Электронный мультимедийный учебник разработчика системы Statistica. <http://www.statsoft.ru/home/portal/>

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для реализации данной дисциплины имеются специальные помещения для проведения занятий лекционного и практического типов, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

Перечень используемого лицензионного программного обеспечения: Windows, Microsoft Office.

Компьютерная техника, используемая в учебном процессе, имеет лицензионное программное обеспечение:

- Операционная система семейства Microsoft Windows.
- Пакет офисных программ Microsoft Office.
- Консультант+.

Рабочую программу составил К. В. Ч., Факультет педагогики и Экономические инноваций и фрезеровка Иван С. А. Углов

Рецензент (представитель работодателя):

ген. директор ООО «Континент-М» Байков



Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры ЭИиФ

Протокол № 10 от 24.06.2022 года

Заведующий кафедрой Кочин О. А. Демин
(ФИО, подпись)

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии направления 38.03.01 «Экономика»

Протокол № 10 от 24.06.2022 года

Председатель комиссии Защ А. В. Захаров
(ФИО, подпись)

10

**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____